

Présentation trimestrielle du portefeuille

Au 31 décembre 2018

Aperçu du portefeuille

| Répartition effective du portefeuille | % de la valeur liquidative |
|---|-----------------------------------|
| Obligations | 98,8 |
| <i>Obligations</i> | 87,3 |
| <i>Positions acheteur sur contrats à terme*</i> | 11,6 |
| <i>Positions vendeur sur contrats à terme**</i> | (0,1) |
| Actions | 2,4 |
| <i>Positions acheteur sur contrats à terme†</i> | 1,6 |
| <i>Actions</i> | 0,8 |
| <i>Positions vendeur sur contrats à terme††</i> | 0,0 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 1,7 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,5 |
| Trésorerie et placements à court terme [§] | (3,4) |

| Répartition régionale effective | % de la valeur liquidative |
|---|-----------------------------------|
| Canada | 68,8 |
| États-Unis | 20,8 |
| Australie | 3,3 |
| Royaume-Uni | 2,5 |
| Allemagne | 2,3 |
| Japon | 1,9 |
| Autres | 1,1 |
| France | 1,0 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,5 |
| Pays-Bas | 0,4 |
| Belgique | 0,2 |
| Luxembourg | 0,2 |
| Suisse | 0,1 |
| Irlande | 0,1 |
| Nouvelle-Zélande | 0,1 |
| Israël | 0,1 |
| Trésorerie et placements à court terme [§] | (3,4) |

| Répartition sectorielle effective | % de la valeur liquidative |
|---|-----------------------------------|
| Obligations de sociétés | 40,6 |
| Obligations fédérales | 31,7 |
| Obligations d'État étrangères | 15,0 |
| Obligations provinciales | 7,2 |
| Prêts à terme | 3,1 |
| Autres | 1,9 |
| Fonds/billets négociés en bourse | 1,7 |
| Titres adossés à des créances hypothécaires | 0,7 |
| Autres éléments d'actif (de passif) | 0,5 |
| Obligations supranationales | 0,3 |
| Énergie | 0,2 |
| Services financiers | 0,2 |
| Titres adossés à des créances mobilières | 0,2 |
| Services publics | 0,1 |
| Trésorerie et placements à court terme [§] | (3,4) |

| Exposition nette effective aux devises | % de la valeur liquidative |
|---|-----------------------------------|
| Dollar canadien | 88,8 |
| Dollar américain | 11,0 |
| Euro | 0,1 |
| Livre sterling | 0,1 |

La répartition effective présente l'exposition du Fonds par portefeuille, région ou secteur ou l'exposition nette aux devises calculée en combinant les placements directs et indirects du Fonds.

Les 25 principaux titres acheteur

| Émetteur/Fonds sous-jacent | % de la valeur liquidative |
|--|-----------------------------------|
| Fonds d'obligations canadiennes Symétrie, série R | 54,3 |
| Fonds d'obligations souveraines Mackenzie, série R | 19,8 |
| Fonds du marché monétaire canadien Mackenzie, série R | 8,7 |
| Trésorerie et placements à court terme | 8,3 |
| Fonds mondial lié à l'inflation Mackenzie, série R | 5,0 |
| Fonds d'obligations mondiales Symétrie, série R | 1,8 |
| Fonds multistratégie à rendement absolu Mackenzie, série R | 1,7 |
| Fonds d'actions canadiennes Symétrie, série R | 0,3 |
| Fonds d'obligations de sociétés Mackenzie, série R | 0,2 |
| Fonds d'actions EAFE Symétrie, série R | 0,1 |
| FINB Obligations toutes sociétés canadiennes Mackenzie | 0,1 |
| Contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans* | 0,1 |
| Contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME* | 0,1 |
| WisdomTree CBOE S&P 500 PutWrite Strategy Fund | 0,0 |
| Catégorie Mackenzie Marchés émergents, série R | 0,0 |
| Fonds d'actions américaines Symétrie, série R | 0,0 |
| Contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans* | 0,0 |
| Contrats à terme sur euro-obligations* | 0,0 |
| Contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225 [†] | (0,1) |

| | |
|---|--------------|
| Principales positions acheteur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale | 100,4 |
|---|--------------|

* Les valeurs du capital théorique représentent 4,3 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations canadiennes à 10 ans, 4,2 % de la valeur liquidative des contrats à très long terme sur obligations du Trésor américain de CME, 2,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor du Commonwealth à 10 ans et 0,4 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur euro-obligations.

** Les valeurs du capital théorique représentent -2,6 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans.

† Les valeurs du capital théorique représentent 1,7 % de la valeur liquidative des contrats à terme libellés en yens sur l'indice Nikkei 225.

†† Les valeurs du capital théorique représentent -0,5 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500 et -0,2 % de la valeur liquidative des contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60.

§ Une portion de la répartition effective de la trésorerie du Fonds est investie dans des titres de série R d'un fonds du marché monétaire géré par Mackenzie.

Pour le prospectus et d'autres renseignements concernant le ou les fonds sous-jacents du portefeuille, veuillez consulter les adresses suivantes : www.placementsmackenzie.com ou www.sedar.com.

Présentation trimestrielle du portefeuille (suite)

Au 31 décembre 2018

Les 25 principaux titres vendeur

| Émetteur | % de la valeur liquidative |
|---|-----------------------------------|
| Contrats à terme sur l'indice E-Mini S&P 500 ^{††} | 0,0 |
| Contrats à terme sur l'indice S&P/TSX 60 ^{††} | 0,0 |
| Contrats à terme sur obligations du Trésor américain à 10 ans ^{**} | (0,1) |

Principales positions vendeur en tant que pourcentage de la valeur liquidative totale (0,1)

Valeur liquidative totale du Fonds 183,4 millions \$

Les placements et pourcentages peuvent avoir changé depuis le 31 décembre 2018 en raison des opérations de portefeuille continues du Fonds. Les mises à jour trimestrielles des titres sont disponibles dans les 60 jours suivant la fin de chaque trimestre, sauf pour le trimestre se terminant le 31 mars, date de clôture de l'exercice du Fonds, où elles sont disponibles dans les 90 jours.

